

中融中证银行指数分级证券投资基金 2017 年年度报告摘要 2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:海通证券股份有限公司 送出日期:2018年03月30日 重要提示 1.1 重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。



注:本基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, manager, dates, and performance metrics.

2.2 基金产品说明 投资目标 本基金采用指数化投资策略,通过严谨的数量化管理和严格的投研程序,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,实现对中证银行指数的有效跟踪。

Table with 3 columns: Item, Fund Manager, and Custodian. Lists key personnel and their roles.

2.4 信息披露方式 本基金选定的信息披露报纸名称:证券日报 信息披露网站:www.zrfunds.com.cn

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 3.1.1 期间数据和指标 2017年 2016年 2015年6月5日(基金合同生效日)-2015年12月31日

Table with 5 columns: Item, 2017, 2016, 2015, and 2014. Shows financial performance and asset-liability ratios.

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产比例符合基金合同的约定。

4.1 基金管理人及基金托管人 4.1.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Description. Lists the board of directors and their qualifications.

4.2 基金管理人及基金托管人 4.2.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.3 基金管理人及基金托管人 4.3.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.4 基金管理人及基金托管人 4.4.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.5 基金管理人及基金托管人 4.5.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.6 基金管理人及基金托管人 4.6.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.7 基金管理人及基金托管人 4.7.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

4.8 基金管理人及基金托管人 4.8.1 基金管理人 中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融融投资管理有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

5.1 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况 报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金管理人应尽的义务。

Table with 2 columns: Item and Value. Shows audit status and audit opinion.

6.2 审计报告的主要内容 审计报告 我们审计了中融中证银行指数分级证券投资基金(以下简称“中融银行”)财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表、2017年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融中证银行指数分级证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金业务操作的相关规定编制,公允反映了中融银行2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融银行,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

我们根据财务报表使用者关注后附财务报表附注中附带的说明,同时该财务报表系中融银行管理人(以下简称“管理人”)根据《中融中证银行指数分级证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融银行持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

管理人对其他信息负责,其他信息包括中融银行2017年年度报告中披露的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表和我们的审计报告不构成任何其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果存在其他信息与我们在审计过程中获取的事实,在这方面,我们无任何事项需要报告。

Table with 4 columns: Item, 2017, 2016, and 2015. Shows financial data for the fund.

7.1 资产负债表 单位:人民币元 资产 附注号 本期末 2017年12月31日 上年度末 2016年12月31日

7.2 利润表 单位:人民币元 项目 附注号 本期末 2017年12月31日 上年度可比期间 2016年12月31日

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 单位:人民币元 项目 2017年01月01日至2017年12月31日 本期 2016年01月01日至2016年12月31日

7.4 关联方关系 7.4.1 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东

7.4.1.1 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.2 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.3 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.4 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.5 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.6 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.7 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.8 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.9 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.10 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.11 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.12 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.13 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

Table with 4 columns: Item, 2017, 2016, and 2015. Shows financial data for the fund.

7.1 资产负债表 单位:人民币元 资产 附注号 本期末 2017年12月31日 上年度末 2016年12月31日

7.2 利润表 单位:人民币元 项目 附注号 本期末 2017年12月31日 上年度可比期间 2016年12月31日

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 单位:人民币元 项目 2017年01月01日至2017年12月31日 本期 2016年01月01日至2016年12月31日

7.4 关联方关系 7.4.1 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东

7.4.1.1 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.2 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.3 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.4 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.5 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.6 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.7 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.8 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.9 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.10 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.11 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.12 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东

7.4.1.13 关联方名称 与本基金的关系 中融国际信托有限公司 基金管理人股东 上海融融投资管理有限公司 基金管理人股东